

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 İTİBARIYLA
PAY FİYATININ HAZIRLANMASINA DAYANAK TEŞKİL EDEN
PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU VE TOPLAM DEĞER/NET VARLIK
DEĞERİ TABLOSUNU İÇEREN FİYAT RAPORLARININ
MEVZUATA UYGUN OLARAK HAZIRLANMASINA İLİŞKİN RAPOR



**AVIVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş.
OKS STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU**

**PAY FİYATININ HAZIRLANMASINA DAYANAK TEŞKİL EDEN PORTFÖY DEĞERİ
TABLOSU VE TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSUNU İÇEREN FİYAT
RAPORLARININ MEVZUATA UYGUN OLARAK HAZIRLANMASINA İLİŞKİN RAPOR**

Avivasa Emeklilik ve Hayat A.Ş. OKS Standart Emeklilik Yatırım Fonu'nun ("Fon") Pay Fiyatının Hazırlanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporlarının 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Standartlarına İlişkin Tebliğ (II-14.2)" hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını Sermaye Piyasası Kurulu'nun konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2019 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Avivasa Emeklilik ve Hayat A.Ş. OKS Standart Emeklilik Yatırım Fonu'nun Pay Fiyatının Hazırlanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporları 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Standartlarına İlişkin Tebliğ (II-14.2)" hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanmıştır.

Bu rapor tamamen Sermaye Piyasası Kurulu ve Fon Kurulu ile Avivasa Emeklilik ve Hayat A.Ş.'nin bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka bir maksatla kullanılması mümkün değildir.

PwC Bağımsız Denetim ve
Serbest Muhasebeci Mali Müşavirlik A.Ş.


Adnan Aran, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 21 Nisan 2020

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Vadeye	Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Borsa	Repo	Net	Günlük				
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Kalan Gün	Oran	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	İskonto	Sözleşme	Teminat	Dönüş	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
						Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	No	Tutar	Tutarı	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
HİSSE SENETLERİ																		
Hisse Türk																		
AEFES	AEFES					7.000		23,55	30.12.2019		801005115010420300			23,08		161.560	0,91	0,04
AKBNK	AKBANK T.A.S.					194.850	7,34	27.12.2019			801005114922669000			8,11		1.580.234	8,88	0,40
ALARK	ALARK					30.000	6,01	30.12.2019			801005115010407580			5,95		178.500	1,00	0,05
ALKIM	ALKIM					3.650	32,83	27.12.2019			801005114922669100			38,32		139.868	0,79	0,03
ANACM	ANACM					33.230	3,60	27.12.2019			801005114922669220			4,36		144.883	0,81	0,04
ARCLK	ARCLK					15.460	18,20	27.12.2019			801005114922669260			20,84		322.186	1,81	0,08
ASELS	ASELS					24.550	18,80	27.12.2019			801005115026146740			20,94		514.077	2,89	0,13
ASELS	ASELS					5.000	21,06	31.12.2019			801005115026146740			20,94		104.700	0,59	0,03
BIMAS	BIMAS					14.420	47,14	27.12.2019			801005114923106820			46,66		672.837	3,78	0,17
ENJSA	ENERJISA ELEKTRİK					53.470	6,63	27.12.2019			801005115010335930			7,39		395.143	2,22	0,10
ENJSA	ENERJISA ELEKTRİK					-25.000	6,63	30.12.2019			801005115010335930			7,39		-184.750	-1,04	-0,05
EREGL	EREGL					102.350	7,21	27.12.2019			801005115010453540			9,04		925.244	5,20	0,23
EREGL	EREGL					10.000	9,05	30.12.2019			801005115010453540			9,04		90.400	0,51	0,02
FROTO	FROTO					3.730	63,39	27.12.2019			801005114922669920			70,85		264.271	1,49	0,07
GARAN	T.GARANTİ BANKASI A.Ş.					166.120	9,67	27.12.2019			801005115010316150			11,14		1.850.577	10,42	0,47
GARAN	T.GARANTİ BANKASI A.Ş.					-17.000	9,67	30.12.2019			801005115010316150			11,14		-189.380	-1,06	-0,05
ISCTR	T.İŞ BANKASI A.Ş.					127.090	5,88	27.12.2019			801005114922670020			6,41		814.647	4,58	0,21
KCHOL	KCHOL					23.720	18,67	27.12.2019			801005114923127520			20,32		481.990	2,71	0,12
KORDS	KORDS					12.520	12,02	27.12.2019			801005114922670100			13,08		163.762	0,92	0,04
KOZAL	KOZA ALTIN İŞLETMELERİ A.Ş.					8.220	70,88	27.12.2019			801005114922733300			74,05		608.691	3,42	0,15
MGROS	MİGROS TİCARET A.Ş.					15.780	21,77	27.12.2019			801005115023485660			24,22		382.192	2,15	0,10
MGROS	MİGROS TİCARET A.Ş.					4.000	24,40	31.12.2019			801005115023485660			24,22		96.880	0,54	0,03
OTKAR	OTKAR					940	143,78	27.12.2019			801005114923145580			159,00		149.460	0,84	0,04
PETKM	PETKM					95.570	3,57	27.12.2019			801005114922670320			3,81		364.123	2,05	0,09
PGSUS	PGSUS					7.240	71,77	27.12.2019			801005114922670360			86,40		625.536	3,52	0,16
SAHOL	SAHOL					64.350	8,90	27.12.2019			801005114923160480			9,54		613.899	3,45	0,16
SISE	SISE					36.990	4,65	27.12.2019			801005114922670440			5,27		194.937	1,10	0,05
SODA	SODA					25.410	5,77	27.12.2019			801005115024282460			6,18		157.036	0,88	0,04
SODA	SODA					20.000	6,17	31.12.2019			801005115024282460			6,18		123.600	0,69	0,03
TCELL	TCELL					80.840	12,74	27.12.2019			801005115010366850			13,80		1.115.592	6,27	0,28
TCELL	TCELL					-10.000	12,74	30.12.2019			801005115010366850			13,80		-138.000	-0,78	-0,04

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

Menkul					Nominal	Faiz	Nominal	Birim	Satın	İç	Borsa	Repo	Net	Günlük				
Kıymet	İhraççı	Vade	Menkul	Vadeye	Faiz	Ödeme	Deger/	Alış	Alış	İskonto	Sözleşme	Teminat	Dönüş	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam
	Kurum	Tarihi	Tanımı	Kalan Gün	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı	No	Tutar	Tutarı	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)
HİSSE SENETLERİ																		
Hisse Türk																		
THYAO	THYAO							64.850	12,51	27.12.2019				14,46		937.731	5,27	0,24
THYAO	THYAO							30.000	14,25	30.12.2019				14,46		433.800	2,44	0,11
TKFEN	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.							9.260	19,85	27.12.2019				19,32		178.903	1,01	0,04
TKFEN	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.							9.000	19,58	30.12.2019				19,32		173.880	0,98	0,04
TOASO	TOASO							19.270	22,80	27.12.2019				26,86		517.592	2,91	0,13
TSKB	TSKB							283.100	0,97	27.12.2019				1,21		342.551	1,93	0,09
TSKB	TSKB							-100.000	0,97	30.12.2019				1,21		-121.000	-0,68	-0,03
TTKOM	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.							103.030	6,29	27.12.2019				7,37		759.331	4,27	0,19
TUPRS	TUPRS							7.010	128,96	27.12.2019				126,80		888.868	5,00	0,23
VAKBN	T.VAKIFLAR BANKASI T.A.O.							80.190	4,71	27.12.2019				5,51		441.847	2,48	0,11
YATAS	YATAS							62.420	6,39	27.12.2019				7,34		458.163	2,58	0,12
YATAS	YATAS							-30.000	6,39	30.12.2019				7,34		-220.200	-1,24	-0,06
YKBNK	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.							108.601	2,47	27.12.2019				2,48		269.330	1,51	0,07
GRUP TOPLAMI								1.781.231								17.785.490	100,00	4,50
BORÇLANMA SENETLERİ																		
Devlet Tahvili																		
TRT150120T16	HAZİNE	15.01.2020				0,00		205.000	103,62	30.12.2019	10,58	0A073C42000CD499		104,84		214.932	0,08	0,05
TRT150120T32	HAZİNE	15.01.2020				96,50		2.140.000	86,90	31.12.2019	10,49	7.19723E+17		99,62		2.131.829	0,79	0,54
TRT050220T17	HAZİNE	5.02.2020				0,00		1.138.000	97,83	26.12.2019	10,54	09FC8C4200082E9A		102,71		1.168.819	0,43	0,30
TRT130520T14	HAZİNE	13.05.2020				0,00		85.000	86,04	12.12.2019	10,67	09FC2082000E1974		96,37		81.919	0,03	0,02
TRT100620T16	HAZİNE	10.06.2020				95,59		34.450.000	92,89	30.12.2019	11,00	722770849056751139		95,50		32.900.540	12,20	8,34
TRT080720T19	HAZİNE	8.07.2020				99,10		34.900.000	99,15	25.12.2019	10,81	722019057981251522		103,97		36.286.311	13,46	9,19
TRT120820T12	HAZİNE	12.08.2020				107,25		2.000.000	110,91	11.10.2019	10,71	719604255568481512		116,12		2.322.308	0,86	0,59
TRT160920T25	HAZİNE	16.09.2020				92,67		33.550.000	87,23	31.12.2019	11,31	722810706353103318		92,68		31.094.206	11,53	7,88
TRT071020T23	HAZİNE	7.10.2020				0,00		30.000.000	90,92	31.12.2019	11,27	0A07CC42000C5292		92,13		27.639.588	10,25	7,00
TRT170221T12	HAZİNE	17.02.2021				0,00		27.000.000	100,55	19.12.2019	11,45	0A06414200091EA3		103,46		27.934.393	10,36	7,08
TRT210421T14	HAZİNE	21.04.2021				106,80		4.500.000	117,20	16.10.2019	11,47	719802167661603518		115,54		5.199.452	1,93	1,32

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Vadeye Kalan Gün	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödemesi	Nominal Deger/Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Borsa Sözleşme No	Repo Teminat Tutarı	Net Dönüş Tutarı	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)
BORÇLANMA SENETLERİ																		
Devlet Tahvil																		
TRT220921T18	HAZİNE	22.09.2021			95,93		20.000.000	97,80	11.12.2019	11,61	721979475562352837			99,28		19.855.976	7,36	5,03
TRT201021T25	HAZİNE	20.10.2021			0,00		21.358.918	105,14	31.12.2019	11,77	0A076082000A694F			106,41		22.728.332	8,43	5,76
TRT120122T17	HAZİNE	12.01.2022			95,15		14.000.000	93,64	4.11.2019	11,68	720554233614914190			101,14		14.159.543	5,25	3,59
TRT020322T17	HAZİNE	2.03.2022			93,35		12.000.000	94,17	21.10.2019	11,71	719881332498817975			102,90		12.347.667	4,58	3,13
TRT140922T17	HAZİNE	14.09.2022			0,00		6.000.000	88,00	12.11.2019	11,44	0A00E842000CF771			96,48		5.789.077	2,15	1,47
TRT180123T10	HAZİNE	18.01.2023			0,00		10.000.000	99,76	27.11.2019	11,66	0A030482000CE7C3			107,64		10.763.752	3,99	2,73
GRUP TOPLAMI							253.326.918									252.618.644	93,68	64,02
Özel Sektör																		
Finansman Bonosu																		
TRFAKBK32013	AKBANK T.A.S.	26.03.2020			2,00		17.000.000	100,00	25.12.2019	0,00				100,20		17.034.848	6,32	4,32
GRUP TOPLAMI							17.000.000									17.034.848	6,32	4,32
GRUP TOPLAMI							270.326.918									269.653.492	100,00	68,34
T.REPO																		
TRT030523T13	HAZİNE	2.01.2020			11,36		7.004.357	11,36	31.12.2019		722810706353312434	3.839.990	7.004.357	11,38		7.002.174	100,00	1,77
GRUP TOPLAMI							7.004.357									7.002.174	100,00	1,77
MEVDUAT																		
T.VAKIFLAR BANKASI T..		2.01.2020			10,25		9.005.618		31.12.2019				9.010.662	10,25		9.008.132	16,58	2,28
TC ZIRAAT BANKASI		2.01.2020			10,25		5.000.000		31.12.2019				5.002.801	10,25		5.001.396	9,20	1,27
AKBANK T.A.S.		8.01.2020			12,00		8.121.808		29.11.2019				8.228.324	12,00		8.209.532	15,11	2,08
AKBANK T.A.S.		8.01.2020			12,00		6.610.235		2.12.2019				6.690.425	12,00		6.675.138	12,28	1,69
AKBANK T.A.S.		20.01.2020			11,50		3.037.726		11.12.2019				3.075.905	11,50		3.057.661	5,63	0,77
T.İŞ BANKASI A.S.		27.02.2020			11,50		7.877.364		29.11.2019				8.100.342	11,50		7.958.156	14,64	2,02
T.VAKIFLAR BANKASI T..		5.03.2020			14,50		6.528.976		5.09.2019				7.001.030	14,50		6.831.264	12,57	1,73
T.İŞ BANKASI A.S.		5.03.2020			11,50		1.118.564		6.12.2019				1.150.220	11,50		1.127.575	2,08	0,29
TC ZIRAAT BANKASI		6.04.2020			13,75		6.234.369		20.09.2019				6.701.733	13,75		6.472.052	11,91	1,64
GRUP TOPLAMI							53.534.660									54.340.907	100,00	13,77

AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS STANDART EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2019 TARİHLİ FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

					Nominal	Faiz		Nominal	Birim	Satın	İç		Borsa	Repo	Net	Günlük							
Menkul	İhraççı	Vade	Menkul	Vadeye	Faiz	Ödeme		Deger/	Alış	Alış	İskonto		Sözleşme	Teminat	Dönüş	Birim	Günlük	Toplam	Grup	Toplam			
Kıymet	Kurum	Tarihi	Tanımı	Kalan Gün	Oranı	Sayısı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tarihi	Oranı			No	Tutar	Tutarı	Deger	Kur	Deger	(%)	(%)			
DİĞER																							
Y.Fonu Türk																							
AGN-AK PORTFÖY YÖN.A.Ş. GİRİŞİM SER.YAT.FONU	AKPORTFOY							6.410.000	1,34	8.02.2019						1,73		11.093.210	24,19	2,81			
BGY-AK PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş. BİRİNCİ GAYRİMENKUL YATIRIM FONU	AKPORTFOY							7.080.000	1,30	22.08.2019						1,41		9.950.083	21,69	2,52			
IAG – İŞ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş. ALTYAPI GİRİŞİM SERMAYESİ YATIRIM FONU	İŞ PORTFÖY							770.000	1,30	27.09.2019						1,35		1.038.728	2,26	0,26			
ICI-AK PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş. İKİNCİ GİRİSİM SERMAYESİ YATIRIM FONU	AKPORTFOY							5.940.322	1,09	22.08.2019						1,17		6.965.265	15,18	1,77			
IKG-AKPORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş. İKİNCİ GAYRİMENKUL YATIRIM FONU	AKPORTFOY							8.587.246	1,11	6.11.2019						1,17		10.081.392	21,98	2,55			
ISZ-İŞ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş. BİRİNCİ GAYRİMENKUL YATIRIM FONU								5.110.000	1,10	8.11.2018						1,32		6.743.294	14,70	1,71			
GRUP TOPLAMI								33.897.568													45.871.973	100,00	11,62
FON PORTFÖY DEĞERİ																		394.654.037		100,00			

**AVİVASA EMEKLİLİK VE HAYAT A.Ş. OKS STANDART EMEKLİLİK
YATIRIM FONU**

31 ARALIK 2019 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

	31 Aralık 2019		
	Tutar	Grup	Toplam
	TL	%	%
A,FON PORTFÖY DEĞERİ	394.654.037		100
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ			
B,HAZIR DEĞERLER	517.082		-
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	517.082	100	-
i) TL Hesaplar			
ii) Yabancı Para TL Karşılığı			
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)			
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C,ALACAKLAR	1.509.682		-
Takastan Alacaklar	1.509.682	100	-
a) Takastan Alacaklar T1	-		-
b) Takastan Alacaklar T2	1.061.403		-
c) İleri Valörlü Takas	448.279		-
d) Diğer Alacaklar	-		-
D,DİĞER VARLIKLAR			
E,BORÇLAR	(2.431.441)		(1)
a) Takasa Borçlar	(1.457.932)	60	-
i) Takasa Borçlar T1	-		
ii) Takasa Borçlar T2	(1.131.632)		
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	(326.300)		
b) Yönetim Ücreti	(273.502)	11	-
c) İhtiyatlar	-	0	-
d) Kayda Alma ücreti	-	0	-
e) Diğer Borçlar	(11.830)	0	-
i) Denetim Ücreti	(688.177)	29	-
vi) Diğer	(685.027)		-
F. M.D.Düşüş Karşılığı			
Fon toplam değeri	394.249.361		100